

中信建投证券股份有限公司

关于正式设立紫晶存储事件先行赔付专项基金的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性依法承担法律责任。

重要提示：

（一）2023 年 4 月 21 日，中信建投证券股份有限公司（以下简称中信建投或公司）公告了《关于拟设立紫晶存储事件先行赔付专项基金与申请适用证券期货行政执法当事人承诺制度的公告》。经筹备，公司会同致同会计师事务所（特殊普通合伙）、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）、广东恒益律师事务所正式设立紫晶存储事件先行赔付专项基金（以下简称专项基金），用于先行赔付适格投资者的投资损失。

（二）专项基金设立的目的在于先行赔付适格投资者因广东紫晶信息存储技术股份有限公司（以下简称紫晶存储）欺诈发行、信息披露违法违规（以下简称紫晶存储事件）而遭受的投资损失。

（三）专项基金由中国证券投资者保护基金有限责任公司担任管理人。专项基金根据《中华人民共和国证券法》《最高人民法院关于审理证券市场虚假陈述侵权民事赔偿案件的若干规定》（法释〔2022〕2 号）的规则和标准，依法确定具体的专项基金赔付范围和赔付金额计算方法。赔付金额以适格投资者因紫晶存储事件而实际发生的损失为限，并依法扣减证券市场风险因素所致损失。

专项基金赔付范围及赔付金额计算方法一经公告，在专项基金存续期间内不可变更及撤销。

（四）因紫晶存储事件而遭受投资损失的适格投资者，如果接受赔付，则表明其愿意与专项基金出资人达成和解，自愿谅解专项基金出资人在紫晶存储事件中的责任，并将对紫晶存储事件相关责任方主张虚假陈述损失赔偿的权利转让给

专项基金出资人，自身不再向紫晶存储事件的责任方索赔。

（五）中国证监会《行政处罚决定书》（〔2023〕30号）认定的责任方和首次公开发行前持有紫晶存储股份的股东，及前述主体的关联人，不属于先行赔付对象；紫晶存储控股股东及董事、监事、高级管理人员增持买入紫晶存储股票，不属于先行赔付对象。

（六）投资者于本公告“二、专项基金的赔付范围”之外的紫晶存储股票投资损失不属于专项基金的赔付范围。

（七）对于因各种原因，未能在指定期间内接受先行赔付的适格投资者，可以与专项基金出资人达成仲裁协议后向仲裁机构申请仲裁，或依法向有管辖权的人民法院提起诉讼等。

（八）专项基金出资人对紫晶存储及其控股股东、实际控制人在《首次公开发行股票并在科创板上市招股说明书》中所作“购回发行人本次公开发行的全部新股”的承诺不承担责任，专项基金的赔付范围不包括该等股份回购责任。

为保护投资者合法利益，维护证券市场稳定，中信建投作为紫晶存储的保荐机构和主承销商，会同紫晶存储其他中介机构致同会计师事务所（特殊普通合伙）、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）、广东恒益律师事务所共同出资设立专项基金，用于先行赔付适格投资者的投资损失。

现将专项基金相关事项公告如下：

一、专项基金基本情况

（一）专项基金出资人

中信建投证券股份有限公司、致同会计师事务所（特殊普通合伙）、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）、广东恒益律师事务所。

（二）专项基金管理人

中国证券投资者保护基金有限责任公司同意接受专项基金出资人的委托，担任专项基金的管理人，负责专项基金的日常管理及运作。

专项基金管理人成立赔付工作组执行基金日常事务。

（三）专项基金托管银行

专项基金托管银行为中信银行股份有限公司北京分行。

专项基金托管银行应安全、完整地托管专项基金项下基金资金，对基金资金单独设置账户、实行严格的分账管理，确保托管的基金资金与其自有资金及其他托管财产之间相互独立。

（四）专项基金规模

专项基金设立出资规模为人民币 10 亿元。

专项基金出资人已于本公告刊登前将设立出资额人民币 10 亿元足额划付至专项基金资金托管账户。若最终完成有效申报的适格投资者损失赔付金额高于上述设立出资金额，专项基金出资人将在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司完成资金划付前将差额资金及时出资到账。

（五）专项基金的成立

专项基金自本公告首次刊登之日起成立。

（六）专项基金存续期限

专项基金的存续期限为自专项基金成立之日起 2 个月。专项基金管理人可根据专项基金运作的实际情况延长专项基金存续期限。专项基金存续期限届满将由专项基金管理人聘请独立的第三方会计师事务所对专项基金进行审计，并组织清算。

二、专项基金的赔付范围

投资者交易紫晶存储股票具备如下情形的，属于专项基金的赔付对象：在 2020 年 1 月 31 日至 2022 年 2 月 11 日（含）期间买入，且在 2022 年 2 月 11 日仍持有紫晶存储股票（包括紫晶存储向社会公众首次公开发行的股票），在 2022 年 2 月 12 日至 2022 年 3 月 15 日（含）之间卖出紫晶存储股票或在 2022 年 3 月 15 日之前未卖出紫晶存储股票，扣除证券市场风险因素所致损失后仍存在亏损的。（不同情形下适格投资者因紫晶存储事件而实际发生的损失，即本次赔付金额的计算方法详见后文）

中国证监会《行政处罚决定书》（〔2023〕30 号）认定的责任方和首次公开发行前持有紫晶存储股份的股东，及前述主体的关联人，不属于先行赔付对象；

紫晶存储控股股东及董事、监事、高级管理人员增持买入紫晶存储股票，不属于先行赔付对象。

说明：

1、2020年1月31日，紫晶存储在指定媒体刊登《首次公开发行股票并在科创板上市招股意向书》，该日是紫晶存储欺诈发行的虚假陈述实施日。

2、2020年4月23日，紫晶存储在指定媒体刊登《2019年年度报告》，2021年4月30日，紫晶存储在指定媒体刊登《2020年年度报告》，这些日期是紫晶存储上市后信息披露违法违规的虚假陈述实施日。

3、2022年2月12日，紫晶存储公告被中国证监会立案调查，该日是紫晶存储证券虚假陈述的揭露日。

4、2022年3月15日，揭露日起紫晶存储股票集中交易累计成交量达到可流通部分的100%之日，该日是紫晶存储证券虚假陈述的基准日。

三、赔付金额的计算方法

专项基金的赔付金额以适格投资者因紫晶存储事件而实际发生的损失为限。

专项基金按照以下公式计算每一适格投资者的赔付金额，其中投资差额损失以投资者买入紫晶存储股票时点所处一级市场、二级市场不同阶段分别计算，并依法分别扣减证券市场风险因素所致损失。

赔付金额=投资差额损失+投资差额损失部分的佣金和印花税。

（一）投资差额损失的计算方法

投资差额损失以投资者买入紫晶存储股票时点所处不同阶段分别计算，具体分为以下情形：

1、一级市场投资差额损失：投资者在2020年1月31日起至2020年2月25日（紫晶存储股票上市前一日）期间参与紫晶存储首次公开发行股票时申购买入，并持续持有至2022年2月11日的紫晶存储股票

（1）投资者在2022年2月12日（含）至3月15日（含）期间卖出的，其投资差额损失（卖出损失）按“发行价格”与“实际卖出平均价格”之差，乘以适格投资者卖出的紫晶存储股票数量，扣减证券市场风险因素所致损失。

（2）投资者在2022年3月15日之前未卖出的，其投资差额损失（持有损

失)按“发行价格”与“基准价格(复权后价格)”之差,乘以适格投资者未卖出的紫晶存储股票数量,扣减证券市场风险因素所致损失。

适格投资者同时存在一级市场卖出损失和持有损失的,投资差额损失为根据上述计算方法计算的卖出损失和持有损失之和,并扣减证券市场风险因素所致损失。已经除权的股票,计算投资差额损失时,股票价格和数量采用“后复权”的方式复权计算。

2、二级市场投资差额损失:投资者在2020年2月26日(紫晶存储股票上市之日)起至2022年2月11日(含)期间买入,并持续持有至2022年2月11日的紫晶存储股票

(1)投资者在2022年2月12日(含)至3月15日(含)期间卖出的,其投资差额损失(卖出损失)按“买入平均价格”与“实际卖出平均价格”之差,乘以适格投资者卖出的紫晶存储股票数量,扣减证券市场风险因素所致损失。

(2)投资者在2022年3月15日之前未卖出的,其投资差额损失(持有损失)按“买入平均价格”与“基准价格(复权后价格)”之差,乘以适格投资者未卖出的紫晶存储股票数量,扣减证券市场风险因素所致损失。

适格投资者同时存在二级市场卖出损失和持有损失的,投资差额损失为根据上述计算方法计算的卖出损失和持有损失之和,并扣减证券市场风险因素所致损失。已经除权的股票,计算投资差额损失时,股票价格和数量采用“后复权”的方式复权计算。

说明:

自2022年2月12日至2022年3月15日期间,紫晶存储每个交易日收盘价的平均值为14.72元/股,即紫晶存储事件损失计算的基准价格为14.72元/股。根据虚假陈述实施日至基准日期间的分红派息情况进行后复权计算,复权后基准价格为15.11元/股(保留两位小数)。

(二)扣减证券市场风险因素所致损失的计算

根据《最高人民法院关于审理证券市场虚假陈述侵权民事赔偿案件的若干规定》(法释〔2022〕2号)第三十一条第二款,“被告能够举证证明原告的损失部分或者全部是由他人操纵市场、证券市场的风险、证券市场特定事件的过度反应、上市公司内外部经营环境等其他因素所导致的,对其关于相应减轻或者免除

责任的抗辩，人民法院应当予以支持。”为保护投资者合法权益，本次先行赔付计算赔偿损失金额时，除扣减证券市场风险因素所致损失外，不再扣减其他因素所致损失。

1、计算原则：采用“个体相对比例法”测算投资者证券市场风险扣除比例。该方法的原理是，从投资者第一笔有效买入开始，假设投资者买卖紫晶存储股票时，同时买入卖出相同数量的指数，每一笔交易均同步对应指数的买入卖出，指数的价格取交易当日的指数数值。揭露后卖出的或持有股票的，假设也同步卖出或持有对应的指数。适格投资者可能不同程度受到证券市场风险因素的影响。

2、参考指数：选择中信计算机指数（CI005027）为计算证券市场风险因素扣除的参考指数。

3、计算方法：将每个投资者持股期间的指数损失比例与个股损失比例进行对比，用“个体相对比例法”计算投资者证券市场风险扣减比例。指数买入均价、卖出均价、基准价、卖出损失、持有损失测算方法同个股的计算方法。

4、计算公式：投资差额损失=A*（1-证券市场风险扣减比例）。

“A”为扣减证券市场风险因素所致损失前的投资差额损失金额，按前述“投资差额损失的计算方法”所列方法，以投资者买入紫晶存储股票时点所处不同阶段分别计算：

“证券市场风险扣减比例”=指数损失比例/个股损失比例。

（1）对于前述一级市场投资差额损失，指数损失比例和个股损失比例的计算公式如下：

指数损失比例=（指数持有损失+指数卖出损失）/（需赔付股数*指数于个股发行日的收盘价）

个股损失比例=（个股持有损失+个股卖出损失）/（需赔付股数*个股发行价格）

（2）对于前述二级市场投资差额损失，指数损失比例和个股损失比例的计算公式如下：

指数损失比例=（指数持有损失+指数卖出损失）/（需赔付股数*指数买入均价）

个股损失比例=（个股持有损失+个股卖出损失）/（需赔付股数*个股买入均

价)

最终计算的证券市场风险扣减比例大于 1，则按 1 计算；证券市场风险扣减比例小于 0，则按 0 计算。

(三) 计算投资差额损失部分的佣金及印花税

扣减证券市场风险因素后的投资差额损失部分的佣金及印花税分别按万分之三的佣金费率、千分之一的印花税率计算。

四、后续公告

敬请紫晶存储投资者务必密切关注专项基金管理人中国证券投资者保护基金有限责任公司官网(<http://www.sipf.com.cn/>)“紫晶存储事件先行赔付专项基金”专栏发布的关于专项基金赔付资金确认和划付的具体流程与操作要求的后续公告，并严格按公告提示进行操作，以避免因未能在公告列明的期限内有效实施操作而带来的不利后果。

特此公告。

中信建投证券股份有限公司董事会

2023 年 5 月 26 日